

OBLIGATIONEN AUSLAND CHF (OAF)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF I	-1.10 %	1.89 %	0.11 %	-0.56	0.04	1.02	0.03 %	-1.88 %	-
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF II	-1.04 %	1.89 %	0.11 %	-0.52	0.60	1.02	0.09 %	-1.85 %	-
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF III	-1.00 %	1.89 %	0.11 %	-0.50	0.97	1.02	0.13 %	-1.83 %	-
<i>SBI For. AAA-BBB</i>	<i>-1.10 %</i>	<i>1.88 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.56</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-1.87 %</i>	<i>-</i>

Beobachtungszeitraum: 01.10.2025 bis 30.09.2026 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF I	2.42 %	1.96 %	0.11 %	1.24	0.09	0.99	0.03 %	-1.88 %	-
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF II	2.48 %	1.96 %	0.11 %	1.27	0.66	0.99	0.09 %	-1.85 %	-
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF III	2.52 %	1.96 %	0.11 %	1.29	1.04	0.99	0.13 %	-1.83 %	-
<i>SBI For. AAA-BBB</i>	<i>2.41 %</i>	<i>1.98 %</i>	<i>-</i>	<i>1.23</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-1.87 %</i>	<i>-</i>

Beobachtungszeitraum: 01.10.2023 bis 30.09.2026 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF I	-0.10 %	3.18 %	0.27 %	-0.02	0.11	0.99	0.03 %	-10.72 %	32.00
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF II	-0.04 %	3.19 %	0.27 %	0.00	0.33	0.99	0.09 %	-10.67 %	31.00
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF III	0.00 %	3.19 %	0.27 %	0.01	0.48	0.99	0.13 %	-10.63 %	31.00
<i>SBI For. AAA-BBB</i>	<i>-0.13 %</i>	<i>3.19 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.03</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-10.50 %</i>	<i>32.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.10.2021 bis 30.09.2026 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF I	-0.10 %	3.31 %	0.35 %	-0.02	-0.29	1.03	-0.10 %	-12.81 %	48.00
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF II	-0.03 %	3.31 %	0.35 %	0.00	-0.10	1.03	-0.04 %	-12.64 %	48.00
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF III	0.01 %	3.31 %	0.35 %	0.01	0.01	1.03	0.00 %	-12.53 %	48.00
<i>SBI For. AAA-BBB</i>	<i>0.00 %</i>	<i>3.20 %</i>	<i>-</i>	<i>0.01</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-12.35 %</i>	<i>48.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.10.2016 bis 30.09.2026 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: -0.04 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr



Kennzahl	Berechnung	Beschreibung
Volatilität	$\sqrt{\text{Varianz}}$	Durchschnittliche Schwankungen der absoluten Rendite um ihren Mittelwert
Sharpe-Ratio	$\frac{\text{Rendite Portfolio p.a.} - \text{risikoloser Zinssatz p.a.}}{\text{Volatilität Portfolio}}$	Absolute Überschussrendite pro Einheit eingegangenem Gesamtrisiko
Tracking Error	Standardabweichung (Rendite Portfolio p.a. – Rendite Benchmark p.a.)	Durchschnittliche Schwankung der Portfoliorendite um die Benchmarkrendite (Volatilität der relativen Rendite = aktives Risiko) Tracking Error zeigt an, wie benchmarknah ein Vermögen verwaltet wird
Information Ratio	$\frac{\text{Rendite Portfolio p.a.} - \text{Rendite Benchmark p.a.}}{\text{Tracking Error}}$	Mehr- oder Minderrendite pro eingegangenem aktiven Risiko
Beta-Faktor	$\frac{\text{Kovarianz zwischen Rendite Portfolio und Rendite Benchmark}}{\text{Varianz Rendite Benchmark}}$	Übernommenes Marktrisiko / Sensibilität auf Preisveränderungen des Marktes
Jensen-Alpha	$\text{Rendite Portfolio p.a.} - \text{risikoloser Zinssatz p.a.} - \beta \times (\text{Rendite Benchmark p.a.} - \text{risikoloser Zinssatz p.a.})$	Durchschnittliche risikobereinigte Mehr- oder Minderrendite
Maximum Drawdown (maximaler kumulierter Verlust)	$\frac{\text{Tiefster Portfoliowert nach Kurseinbruch} - \text{Höchster Portfoliowert vorher}}{\text{Höchster Portfoliowert vorher}}$	Maximaler Gesamtverlust innerhalb eines Betrachtungszeitraumes unabhängig von zwischenzeitlichen teilweisen Erholungen
Recovery Period (Erholungsdauer)	$\frac{\text{Datum Wiedererreichung Höchster Portfoliowert} - \text{Datum Tiefster Portfoliowert}}{\text{nach Kurseinbruch gemäss gewählter Periode bei Maximum Drawdown}}$	Zeitdauer bis zur Kompensation des vorangehenden Maximalverlustes
Modified Duration	$\frac{\text{Restlaufzeitgewichteter Barwert der Obligation}}{\text{Barwert der Obligation}}$	Sensitivitätsmass auf Veränderungen des Zinsniveaus